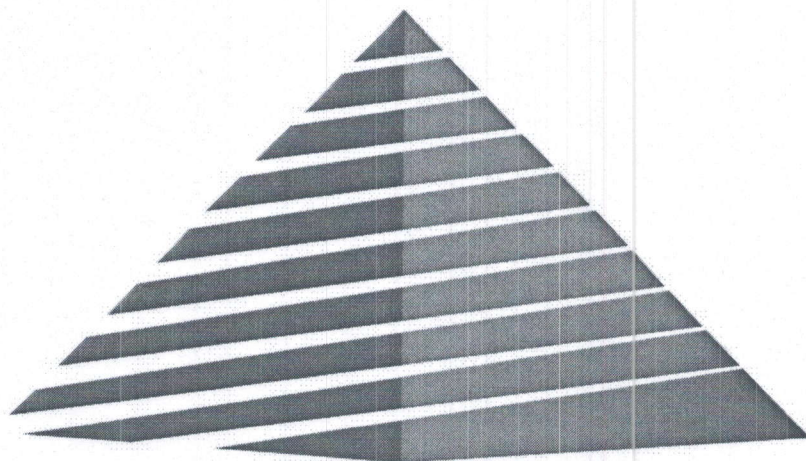




**صندوق سرمایه‌گذاری
اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم**

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۱

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۱



با احترام، به پیوست گزارش عملکرد صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم برای سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۱ که در اجرای بند ۷ ماده ۴۵ اساسنامه صندوق براساس سوابق و مدارک و اطلاعات موجود در خصوص عملیات صندوق تهیه گردیده، به شرح زیر تقدیم می‌گردد:

۲	تاریخچه فعالیت صندوق:
۲	موضوع فعالیت صندوق:
۲	هدف از تشکیل صندوق:
۲	ارکان صندوق:
۳	دوره فعالیت صندوق:
۳	واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق:
۳	دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز:
۳	اطلاع رسانی:
۴	صورت خالص دارایی‌ها:
۴	سود (زیان) حاصل از فروش سهام:
۵	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری سهام:
۶	خرید و فروش سهام:
۸	ترکیب داراییهای صندوق:
۱۰	خلاصه عملکرد صندوق:
۱۰	استراتژی سرمایه‌گذاری صندوق:
۱۰	برنامه ها و فعالیت های آتی:

امضاء

نام و نام خانوادگی

شرکت سبذگردان الگوریتم

حامد حامدی نیا

مدیر صندوق

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۱

تاریخچه فعالیت صندوق:

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم در تاریخ ۱۳۹۴/۱۲/۰۸ تحت شماره ۱۱۴۰۷ نزد سازمان بورس و اوراق بهادار و در تاریخ ۱۳۹۴/۱۱/۲۶ طی شماره ۳۷۹۰۱ نزد اداره ثبت شرکت‌ها با شناسه ملی ۱۴۰۰۵۶۲۰۵۳۸ با نام بازارگردانی آینده‌نگر توسعه سینا به ثبت رسیده است. به موجب صورتجلسه مجمع مورخ ۱۳۹۸/۱۰/۱۵ نام صندوق به صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم تغییر یافت. هدف از تشکیل صندوق، جمع‌آوری وجوه از سرمایه‌گذاران و اختصاص آنها به خرید انواع اوراق بهادار به منظور انجام تعهدات بازارگردانی اوراق بهادار مشخص طبق امیدنامه، بهره‌گیری از صرفه جویی‌های ناشی از مقیاس و تأمین منافع سرمایه‌گذاران است. مطابق مصوبات مجمع مورخ ۱۳۹۸/۰۶/۱۷ و موافقت سازمان بورس و اوراق بهادار طی نامه شماره ۱۲۲/۵۴۰۵۳ مورخ ۱۳۹۸/۰۶/۲۵، سال مالی صندوق از پایان آذر ماه به پایان شهریور ماه تغییر یافت. همچنین به موجب صورتجلسه مجمع مورخ ۱۴۰۰/۱۱/۰۹ مدت فعالیت صندوق به مدت سه سال تا تاریخ ۱۴۰۳/۱۱/۲۵ تمدید گردید. مرکز اصلی صندوق در تهران، خیابان ولیعصر، خیابان بزرگمهر، پلاک ۱۶، واحد ۴۱۰ می‌باشد.

موضوع فعالیت صندوق:

موضوع فعالیت اصلی صندوق، سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار اعلام شده در ماده (۲-۲) امیدنامه با هدف ایفای تعهدات بازارگردانی با شرایط مندرج در امیدنامه و موضوع فعالیت فرعی آن مشارکت در تعهد پذیرهنویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار موضوع بازارگردانی است.

هدف از تشکیل صندوق:

هدف از تشکیل صندوق، جمع‌آوری سرمایه از سرمایه‌گذاران و خرید و فروش اوراق بهادار در چارچوب تعهدات بازارگردانی آن اوراق مطابق امیدنامه و کسب منافع از این محل است. همچنین در صورتی که صرفه و صلاح صندوق ایجاب کند، صندوق در قبال دریافت کارمزد در تعهد پذیرهنویسی یا تعهد خرید اوراق بهادار موضوع بازارگردانی مشارکت کرده، که در این صورت وجوه جمع‌آوری شده و سایر دارایی‌های صندوق، پشتوانه این تعهد خواهد بود. با توجه به پذیرش ریسک مورد قبول، تلاش می‌شود، بیشترین بازدهی ممکن نصیب سرمایه‌گذاران گردد.

ارکان صندوق:

مدیر: مدیر صندوق، شرکت سبدگردان الگوریتم است که در تاریخ ۱۳۹۶/۱۱/۰۳ با شماره ثبت ۵۲۲۰۰۷ نزد مرجع ثبت شرکت‌های شهرستان تهران به ثبت رسیده است. نشانی مدیر عبارت است از: تهران، خیابان ولیعصر، خیابان بزرگمهر، پلاک ۱۶، واحد ۴۱۰.

متولی: متولی صندوق، مؤسسه حسابرسی هوشیار ممیز است که در تاریخ ۱۳۷۸/۰۲/۰۸ به شماره ثبت ۱۱۰۲۱ در اداره ثبت شرکت‌های تهران به ثبت رسیده است. نشانی متولی عبارت است از تهران، خیابان گاندی شمالی، پلاک ۸، طبقه پنجم واحد ۱۹.

حسابرس: حسابرس صندوق، مؤسسه حسابرسی و خدمات مدیریت آزموده‌کاران است که در تاریخ ۱۳۷۹/۰۳/۱۷ به شماره ثبت ۶۷۶۹ نزد مرجع ثبت شرکت‌های تهران به ثبت رسیده است. نشانی حسابرس عبارت است از تهران، شریعتی، قلعهک، کوچه شریف، پلاک ۵.

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۱



دوره فعالیت صندوق :

دوره فعالیت صندوق از تاریخ قید شده در مجوز فعالیت که توسط سازمان به نام صندوق صادر می‌شود شروع شده و از تاریخ ثبت صندوق نزد مرجع ثبت شرکت‌ها به مدت سه سال شمسی ادامه می‌یابد. لیکن مطابق تأییدیه سازمان بورس و اوراق بهادار دوره زمان فعالیت صندوق تا تاریخ ۱۴۰۳/۱۱/۲۵ تمدید شده است. این مدت مطابق ماده ۴۹ اساسنامه قابل تمدید است. سال مالی صندوق به مدت یک سال شمسی، از ابتدای مهرماه هر سال تا انتهای شهریورماه سال بعد است.

واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق :

ارزش مبنای هر واحد سرمایه‌گذاری برابر یک میلیون ریال است که باید روی گواهی‌های سرمایه‌گذاری قید شود. واحدهای سرمایه‌گذاری صندوق به دو نوع ممتاز و عادی به شرح زیر تقسیم می‌شود:

الف) واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز که تعداد آنها ۲۵,۰۰۰ واحد سرمایه‌گذاری است، در زمان تأسیس کلاً توسط مؤسسان صندوق خریداری شده است. این نوع واحدهای سرمایه‌گذاری غیرقابل ابطال ولی قابل انتقال به غیر می‌باشد.

ب) واحدهای سرمایه‌گذاری عادی که تعداد آنها ۲,۴۷۵,۰۰۰ واحد سرمایه‌گذاری است، که در زمان تأسیس یا پس از تشکیل صندوق صادر می‌شود. این نوع واحدهای سرمایه‌گذاری قابل ابطال ولی غیرقابل انتقال می‌باشد. حداکثر واحدهای سرمایه‌گذاری عادی نزد سرمایه‌گذاران در امیدنامه قید شده است.

دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز :

دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز به شرح جدول زیر می‌باشد:

ردیف	نام دارنده واحد سرمایه‌گذاری	نوع واحد	تعداد واحد سرمایه‌گذاری	درصد از کل واحدهای سرمایه‌گذاری ممتاز
۱	شرکت سبدگردان الگوریتم	ممتاز	۱۳,۰۰۰	۵۲
۲	شرکت سرمایه‌گذاری خوارزمی	ممتاز	۷,۰۰۰	۲۸
۳	شرکت تأمین سرمایه سپهر	ممتاز	۴,۰۰۰	۱۶
۴	شرکت کارگزاری آینده‌نگر خوارزمی	ممتاز	۱,۰۰۰	۴
	جمع		۲۵,۰۰۰	۱۰۰

اطلاع‌رسانی:

کلیه اطلاعات مرتبط با فعالیت صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم مطابق با ماده ۴۴ اساسنامه در تارنمای صندوق به آدرس www.kooshafund.ir درج گردیده است.



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۱

صورت خالص دارایی‌ها:

۱۴۰۰/۰۶/۳۱	۱۴۰۱/۰۶/۳۱	دارایی‌ها :
ریال	ریال	
۵۷۰.۹۸۰.۷۶۵.۰۰۱	۵۷۴.۴۱۶.۶۶۴.۹۰۴	سرمایه‌گذاری در سهام و حق تقدم
۳۳.۹۷۲.۱۷۷.۰۲۱	۶.۲۱۹.۲۲۸.۸۵۳	سرمایه‌گذاری در سپرده بانکی
۲۰.۲۸۲۱.۵۵۲.۲۴۴	۲۹۷.۸۶۷.۹۹۸.۹۸۱	سرمایه‌گذاری در سایر اوراق بهادار با در آمد ثابت یا
۹۴۹.۷۷۸.۲۶۳.۹۰۳	۹۲۳.۴۵۳.۶۴۳.۴۸۲	علی‌الحساب
۱۳.۶۸۸.۲۸۵.۸۸۳	۳۴.۱۰۶.۹۵۱.۰۷۹	صندوق‌های سرمایه‌گذاری
۲۴۵.۲۰۶.۴۱۲	۲۷۳.۲۲۹.۱۰۹	حساب‌های دریافتی
		سایر دارایی‌ها
۱.۷۷۱.۴۸۶.۲۵۰.۴۶۴	۱.۸۳۶.۳۳۷.۷۱۶.۴۰۸	جمع دارایی‌ها
		بدهی‌ها :
۴۳۱.۶۵۹.۹۲۱.۱۱۸	۷.۲۴۰.۹۹۹.۳۲۷	جاری کارگزاران
۱۰۰.۷۸۲.۰۵۸۳۵	۵.۷۴۳.۷۲۲.۷۷۹	بدهی به ارکان صندوق
.	۱۰۱.۳۹۲.۹۱۹.۰۰۰	پرداختی به سرمایه‌گذاران
.	۷۳۳.۸۴۸.۱۱۲	تسهیلات مالی دریافتی
.	۹.۴۳۳.۳۸۷.۸۴۵	پیش‌دریافت
۱.۲۵۵.۱۷۴.۹۵۵	۱۰.۷۱۲.۲۶۶.۸۶۶	سایر حسابهای پرداختی و ذخایر
۴۴۲.۹۹۳.۳۰۱.۹۰۸	۱۲۵.۶۱۶.۱۴۳.۹۲۹	جمع بدهی‌ها
۱.۳۲۸.۴۹۲.۹۴۸.۵۵۶	۱.۷۱۰.۷۲۱.۵۷۲.۴۷۹	خالص دارایی‌ها
۱.۱۴۷.۹۶۵	۱.۲۳۷.۲۵۷	خالص دارایی‌های هر واحد سرمایه‌گذاری

سود (زیان) حاصل از فروش سهام شرکت‌های پذیرفته شده در بورس یا فرابورس:

نام شرکت	تعداد	بهای فروش (ریال)	ارزش دفتری (ریال)	کارمزد (ریال)	سود (زیان) فروش (ریال)
پاما	۲۵.۲۹۷.۷۲۶	۲۲۷.۸۵۶.۵۷۶.۰۵۰	(۲۵۴.۹۶۶.۸۸۰.۷۱۸)	(۱۰۲.۹۲۰.۰۹۸)	(۲۷.۲۱۳.۲۲۴.۷۶۶)
سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۶۲.۳۵۳.۴۹۳	۲۰۶.۷۷۹.۵۵۲.۸۷۱	(۲۲۴.۲۴۱.۱۹۰.۸۵۷)	(۱۵۱.۳۷۱.۳۶۰)	(۱۷.۶۱۳.۰۰۹.۳۴۶)
بیمه سرمد	۵۳.۱۷۵.۸۶۸	۱۷۶.۶۲۳.۸۸۷.۵۱۵	(۱۶۸.۲۴۶.۷۴۳.۵۴۱)	(۱۲۳.۷۳۸.۴۰۶)	۸.۲۵۳.۴۰۵.۵۶۸
بیمه رازی	۲۵۵.۶۲۶.۱۰۹	۴۰۹.۵۳۸.۷۵۶.۵۹۷	(۴۱۳.۰۲۸.۸۹۱.۳۸۸)	(۲۸۴.۷۳۶.۹۱۱)	(۳.۷۷۴.۸۷۱.۷۰۲)
داروسازی سینا	۱۳.۲۰۱.۱۲۳	۲۸۹.۷۶۳.۶۱۹.۹۴۰	(۲۷۴.۳۲۱.۹۲۲.۶۳۴)	(۲۱۰.۳۴۶.۳۰۰)	۱۵.۲۳۱.۳۵۱.۰۰۶
جمع	۱۰۹.۶۵۴.۳۱۹	۱.۳۱۰.۵۶۲.۳۹۲.۹۷۳	(۱.۳۳۴.۸۰۵.۶۲۹.۱۳۸)	(۸۷۳.۱۱۳.۰۷۵)	(۲۵.۱۱۶.۳۴۹.۲۴۰)

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۱



سود (زیان) حاصل از فروش واحدهای صندوق سرمایه‌گذاری:

نام صندوق	تعداد	بهای فروش (ریال)	ارزش دفتری (ریال)	کارمزد (ریال)	سود (زیان) فروش (ریال)
ارزش آفرین بیدار	۱۵۰.۳۷۱.۸۷۳	۱.۵۶۲.۳۱۰.۸۷۰.۴۸۰	(۱.۴۹۸.۶۱۳.۶۴۹.۵۷۹)	(۳۱۳.۷۶۲.۲۸۸)	۶۳.۳۸۳.۴۵۸.۶۱۳
دارا الگوریتم	۶۸۸.۲۱۷.۵۱۷	۶.۹۴۱.۲۳۷.۹۳۳.۸۱۶	(۶.۹۳۴.۸۸۲.۶۹۹.۰۷۱)	(۱۸۷.۳۸۵.۲۵۶)	۶.۱۶۷.۸۴۹.۴۸۹
افرا نماد پایدار	۶۸.۱۶۳.۸۳۱	۱.۱۸۰.۹۳۱.۸۹۹.۶۱۳	(۱.۱۷۷.۶۴۸.۱۷۵.۱۵۸)	(۲۲۱.۴۲۱.۹۳۸)	۳.۰۶۲.۳۰۲.۵۱۷
کمند	۴۸.۲۰۲.۰۰۰	۴۸۶.۷۲۷.۰۶۸.۰۰۰	(۴۸۵.۶۲۱.۴۶۰.۳۷۹)	(۹۱.۲۵۹.۷۶۳)	۱۰.۱۴.۳۷۷.۸۵۸
سپر سرمایه بیدار	۴۶۴۷.۵۵۰	۶۷.۷۴۸.۶۱۴.۳۶۶	(۶۷.۷۲۳.۴۳۴.۱۴۳)	(۱۱.۲۵۴.۶۴۷)	۱۳.۹۲۵.۵۷۶
جمع	۹۵۹.۶۰۲.۷۷۱	۱۰.۲۳۸.۹۵۶.۳۸۶.۲۷۵	(۱۰.۱۶۴.۶۸۹.۴۱۸.۲۳۰)	(۸۲۵.۰۸۳.۸۹۲)	۷۳.۶۴۱.۸۸۴.۰۵۳

سود (زیان) حاصل از فروش اوراق مشارکت:

نام اوراق	تعداد	بهای فروش (ریال)	ارزش دفتری (ریال)	کارمزد (ریال)	سود (زیان) فروش (ریال)
صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ماهه ۲۰٪	۱۵۲.۶۴۱	۱۵۱.۹۶۶.۳۳۰.۷۰۰	(۱۵۲.۶۵۸.۴۱۳.۱۵۶)	(۱۷.۵۵۲.۴۱۶)	(۷۰.۹۶۴.۸۷۲)
جمع	۱۵۲.۶۴۱	۱۵۱.۹۶۶.۳۳۰.۷۰۰	(۱۵۲.۶۵۸.۴۱۳.۱۵۶)	(۱۷.۵۵۲.۴۱۶)	(۷۰.۹۶۴.۸۷۲)

سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری سهام شرکت‌های پذیرفته شده در بورس و فرابورس:

نام شرکت	تعداد	ارزش بازار (ریال)	ارزش دفتری (ریال)	کارمزد (ریال)	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری (ریال)
داروسازی سینا	۱۴.۵۰۹.۶۵۶	۳۳۲.۵۶۱.۳۱۵.۵۲۰	(۳۱۷.۹۹۹.۶۰۱.۰۱۱)	(۲۰۲.۱۹۷.۲۸۰)	۱۴.۳۵۹.۵۱۷.۲۲۹
بیمه سرم	۵۱.۱۸۹.۱۹۵	۱۳۸.۹۷۸.۶۶۴.۴۲۵	(۱۳۵.۷۲۳.۴۵۸.۶۴۱)	(۸۴.۴۹۹.۰۲۸)	۳.۱۷۰.۷۰۶.۷۵۶
سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۱۴.۱۴۵.۲۷۰	۲۶.۲۶۷.۷۶۶.۳۹۰	(۲۶.۳۷۰.۴۰۰.۵۸۱)	(۱۵.۹۷۰.۸۰۲)	(۱۱۸۶۰.۴۹۹۳)
بیمه رازی	۴۹.۲۰۶.۱۲۳	۷۶.۹۵۸.۳۷۶.۳۷۲	(۸۶.۲۱۸.۱۵۵.۳۵۲)	(۴۶.۷۹۰.۶۹۳)	(۹.۳۰۶.۵۹۶۷۳)
جمع	۱۲۹.۰۵۰.۲۴۴	۵۷۴.۷۶۶.۱۲۲.۷۰۷	(۵۶۶.۳۱۱.۶۱۵.۵۸۵)	(۳۴۹.۴۵۷.۸۰۳)	۸.۱۰۵.۰۴۹.۳۱۹

سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری واحدهای صندوق سرمایه‌گذاری:

نام صندوق	تعداد	ارزش بازار (ریال)	ارزش دفتری (ریال)	کارمزد (ریال)	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری (ریال)
دارا الگوریتم	۲۳۶۶۰.۴۰۳	۲۴۰.۶۴۹.۹۵۸.۹۱۳	(۲۳۹.۶۸۰.۸۳۷.۶۰۶)	(۷.۲۱۹.۴۹۹)	۹۶۱.۹۰۱.۸۰۸
افرا نماد پایدار	۳۸.۸۵۴.۱۲۵	۶۸۲.۹۳۸.۹۵۵.۱۲۵	(۶۷۲.۸۴۱.۴۴۹.۱۸۵)	(۱۲۸.۰۵۱.۰۵۴)	۹.۹۶۹.۴۵۴.۸۸۶
جمع	۶۲.۵۱۴.۵۲۸	۹۲۳.۵۸۸.۹۱۴.۰۳۸	(۹۱۲.۵۲۲.۲۸۶.۷۹۱)	(۱۳۵.۲۷۰.۵۵۳)	۱۰.۹۳۱.۳۵۶.۶۹۴

سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری اوراق مشارکت:

نام اوراق	تعداد	ارزش بازار (ریال)	ارزش دفتری (ریال)	کارمزد (ریال)	سود (زیان) تحقق نیافته نگهداری (ریال)
صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ماهه ۲۰٪	۲۸۹.۹۹۳	۲۹۱.۴۴۲.۹۶۵.۰۰۰	(۲۹۰.۰۲۶.۶۳۳.۶۱۴)	(۳۳.۵۱۵.۹۴۱)	۱.۳۸۲.۸۱۵.۴۴۵
جمع	۲۸۹.۹۹۳	۲۹۱.۴۴۲.۹۶۵.۰۰۰	(۲۹۰.۰۲۶.۶۳۳.۶۱۴)	(۳۳.۵۱۵.۹۴۱)	۱.۳۸۲.۸۱۵.۴۴۵

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۱



خرید و فروش طی دوره (۳ ماهه منتهی به ۳۰/۰۹/۱۴۰۰):

شرح	تعداد خرید	تعداد فروش	مبلغ خرید (ریال)	مبلغ فروش (ریال)
داروسازی سینا	۵۶۸۹.۴۸۳	۴۸۴۷.۶۷۴	۱۱۶.۰۴۱.۱۲۹.۰۸۱	۱۰۰.۳۱۷.۱۶۲.۲۳۰
بیمه سرمد	۳.۴۶۵.۹۷۱	۵.۵۳۵.۳۶۱	۱۷.۹۷۴.۶۸۲.۷۴۰	۲۸.۲۱۸.۶۳۳.۶۰۱
پاما	۱۱.۹۵۶.۲۲۰	۲۵.۲۹۷.۷۲۶	۱۱۱.۵۲۱.۳۷۷.۶۵۸	۲۲۷.۷۵۳.۶۵۵.۹۵۲
سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۱۵.۳۹۶.۴۲۶	۱۴.۲۷۵.۵۹۲	۸۰.۱۰۳.۷۵۷.۰۰۸	۷۳.۹۷۸.۳۱۳.۲۰۹
بیمه رازی	۱۶.۰۹۴.۸۷۲	۶.۸۲۱.۹۳۸	۲۸.۲۰۵.۵۱۴.۴۱۵	۱۳.۹۱۲.۲۸۲.۱۳۲
صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	۴۳.۸۷۴.۶۱۵	۲۹.۱۰۰.۱۱۰	۴۳۹.۱۰۴.۹۷۶.۱۸۸	۲۹۱.۵۳۶.۰۴۹.۵۸۳
صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	۳۴.۷۸۷.۵۳۱	۳۱.۱۱۹.۵۶۶	۳۴۶.۶۶۸.۰۵۰.۷۹۴	۳۱۹.۰۶۵.۴۶۱.۲۶۰

خرید و فروش طی دوره (۳ ماهه منتهی به ۲۹/۱۲/۱۴۰۰):

شرح	تعداد خرید	تعداد فروش	مبلغ خرید (ریال)	مبلغ فروش (ریال)
شرکت داروسازی سینا	۳۰.۹۲۵.۹۹۱	۲.۳۶۰.۷۳۶	۶۰.۷۹۹.۵۷۱.۸۷۸	۴۷.۶۱۱.۳۶۵.۲۰۱
شرکت بیمه سرمد	۱۶.۲۲۸.۵۷۹	۹.۳۹۲.۰۶۱	۷۳.۲۹۵.۹۹۰.۶۵۵	۴۱.۵۷۵.۰۲۰.۳۶۳
شرکت سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۶۶۸۸.۱۷۵	۱۱.۱۶۳.۹۸۴	۲۶.۸۲۲.۸۸۶.۱۳۳	۴۶.۰۷۸.۳۵۷.۸۳۱
شرکت بیمه رازی	۷۷.۸۰۶.۸۹۰	۱۰۰.۸۱۵.۰۶۴	۹۴.۱۹۸.۰۷۸.۵۷۷	۱۲۶.۳۱۳.۰۶۱.۳۲۶
صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	۵۷.۸۶۸.۸۵۸	۹۹.۶۹۴.۹۱۴	۵۸۰.۳۸۳.۳۶۶.۸۰۷	۱۰۰.۵۸۰.۰۹۴.۱۴۰
صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	۴۸.۵۱۳.۱۸۲	۳۸.۷۷۵.۵۸۶	۴۲۷.۹۶۸.۹۶۰.۳۹۱	۳۵۹.۳۲۰.۳۱۵.۸۵۲
صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ماهه ۲۰٪	۵۲.۶۰۶	۲.۵۱۰	۵۲.۶۰۶.۴۳۳.۵۵۰	۲.۵۰۹.۶۳۶.۰۵۰

خرید و فروش طی دوره (۳ ماهه منتهی به ۳۱/۰۳/۱۴۰۱):

شرح	تعداد خرید	تعداد فروش	مبلغ خرید (ریال)	مبلغ فروش (ریال)
شرکت داروسازی سینا	۴.۵۹۸.۶۷۶	۴.۳۳۸.۶۱۴	۱۱۶.۱۲۹.۹۱۷.۴۰۱	۱۰۳.۳۷۱.۲۰۷.۵۲۰
شرکت بیمه سرمد	۱۴.۴۹۳.۲۱۲	۲۳.۹۶۲.۳۱۳	۴۱.۲۸۰.۱۹۶.۷۲۷	۶۸.۶۷۹.۴۰۲.۰۷۴
شرکت سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۲۸.۷۷۶.۱۰۱	۱۷.۸۳۶.۴۳۰	۷۷.۷۴۶.۴۹۹.۶۰۸	۵۳.۴۴۵.۲۷۵.۴۱۳
شرکت بیمه رازی	۹۵.۶۴۴.۲۹۵	۷۶.۴۳۰.۷۳۹	۱۷۴.۹۸۸.۰۲۳.۳۶۸	۱۴۰.۵۷۳.۴۳۸.۶۵۱
صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	۱۷۳.۱۸۲.۰۴۹	۱۹۵.۸۴۴.۲۵۱	۱.۷۵۰.۱۸۶.۸۷۳.۸۵۶	۱.۹۷۶.۴۱۸.۵۷۴.۷۰۳
صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	۵۰.۱۹۳.۶۲۲	۴۹.۸۲۹.۴۶۵	۵۵۳.۰۳۴.۶۰۲.۴۰۹	۵۴۶.۵۸۴.۰۱۵.۲۲۰
صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ماهه ۲۰٪	۱۹۲.۰۲۸	۳۳	۱۹۲.۰۵۵.۸۴۳.۲۲۰	۳۳.۰۴۵.۴۸۸

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۱



خرید و فروش طی دوره (۳ ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱):

شرح	تعداد خرید	تعداد فروش	مبلغ خرید (ریال)	مبلغ فروش (ریال)
شرکت داروسازی سینا	۱۶۵۲.۱۰۱	۱۶۵۴.۰۹۹	۳۷.۸۷۷.۳۴۲.۴۱۵	۳۸.۲۵۳.۵۳۸.۶۸۹
شرکت بیمه سرمد	۳۵.۳۲۶.۷۴۲	۱۴.۲۸۶.۱۳۳	۹۵.۵۸۴.۷۴۷.۴۰۸	۳۸.۰۲۷.۰۹۳.۰۷۱
شرکت سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۱۴.۵۸۲.۹۱۵	۱۹.۰۷۷.۴۸۷	۲۴.۹۵۸.۴۵۵.۲۱۳	۳۳.۱۲۶.۲۳۵.۰۵۸
شرکت بیمه رازی	۸۷.۷۰۶.۶۶۹	۷۱.۵۵۸.۳۶۸	۱۵۲.۶۰۸.۳۰۹.۴۳۷	۱۲۸.۴۵۵.۲۳۷.۵۷۷
صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	۳۵۴.۱۳۷.۹۸۰	۳۶۳.۵۷۸.۲۴۲	۳.۵۷۱.۸۷۶.۸۳۲.۳۴۵	۳.۶۶۷.۲۹۴.۹۷۸.۱۳۴
صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	۵.۱۱۵.۷۵۴	۳۰.۶۴۷.۲۵۶	۵۴.۱۵۷.۹۳۹.۲۰۸	۳۳۷.۰۲۷.۳۱۵.۸۶۰
صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ماهه ۲۰٪	۱۹۸.۰۰۰	۱۵۰.۰۹۸	۱۹۸.۰۲۲.۷۷۰.۰۰۰	۱۴۹.۴۰۶.۰۹۶.۷۴۶

مقایسه حجم معاملات سهام در صندوق و بازار (۳ ماهه منتهی به ۱۴۰۰/۰۹/۳۰):

شرح	حجم معاملات در صندوق	حجم معاملات بازار	درصد از حجم معاملات بازار
شرکت داروسازی سینا	۱۰.۵۳۷.۱۵۷	۱۶.۱۲۳.۰۱۸	۶۵/۳۵
شرکت بیمه سرمد	۹.۰۰۱.۳۳۲	۴۳.۷۰۲.۴۴۵	۲۰/۶۰
شرکت باما	۳۷.۲۵۳.۹۴۶	۱.۷۲۹.۲۸۵.۶۵۴	۲/۱۵
شرکت سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۲۹.۶۷۲.۰۱۸	۱۱۲.۵۴۳.۲۶۸	۲۶/۳۶
شرکت بیمه رازی	۲۲.۹۱۶.۸۱۰	۲۳۱.۵۵۶.۲۵۶	۹/۹۰
صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	۷۲.۹۷۴.۷۲۵	۱۲۲.۵۶۷.۴۲۸	۵۹/۵۴
صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	۶۵.۹۰۷.۰۹۷	۲۱۷.۱۰۶.۸۰۱	۳۰/۳۶

مقایسه حجم معاملات سهام در صندوق و بازار (۳ ماهه منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹):

شرح	حجم معاملات در صندوق	حجم معاملات بازار	درصد از حجم معاملات بازار
شرکت داروسازی سینا	۵.۴۵۳.۳۲۷	۱۹.۷۶۸.۶۹۲	۲۷/۵۹
شرکت بیمه سرمد	۲۵.۶۲۰.۶۴۰	۱۵۰.۴۰۴.۴۱۹	۱۷/۰۳
شرکت سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۱۷.۸۵۲.۱۵۹	۶۷.۴۴۹.۹۴۹	۲۶/۴۷
شرکت بیمه رازی	۱۷۸.۶۲۱.۹۵۴	۱.۷۶۷.۳۱۸.۰۲۵	۱۰/۱۱
صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	۱۵۷.۵۶۳.۷۷۲	۱۹۷.۷۸۸.۶۹۷	۷۹/۶۶
صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	۸۷.۲۸۸.۷۶۸	۱۶۱.۳۷۴.۸۷۷	۵۴/۰۹
صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱۱-۶ماهه ۲۰٪	۵۵.۱۱۶	۱.۰۰۵.۱۱۶	۵/۴۸

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۱



مقایسه حجم معاملات سهام در صندوق و بازار (۳ ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۳/۳۱):

شرح	حجم معاملات در صندوق	حجم معاملات بازار	درصد از حجم معاملات بازار
شرکت داروسازی سینا	۸.۹۳۷.۲۹۰	۲۶.۱۲۵.۹۸۸	۳۴/۲۱
شرکت بیمه سرمد	۳۸.۴۵۵.۵۲۵	۴۷۷.۶۰۷.۸۸۵	۸/۰۵
شرکت سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۵۱.۸۷۵.۱۴۰	۱۲۹.۳۹۴.۸۷۴	۴۰/۰۹
شرکت بیمه رازی	۱۷۲.۰۷۵.۰۳۴	۲.۷۹۲.۹۹۶.۵۳۳	۶/۱۶
صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	۳۶۹.۰۲۶.۳۰۰	۳۷۲.۶۸۱.۵۴۹	۹۹
صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	۱۰۰.۰۲۳.۰۸۷	۲۱۹.۰۸۵.۵۷۵	۴۵/۶۵
صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱-۶ماهه ۲۰٪	۱۹۲.۰۶۱	۱.۰۰۵.۱۴۹	۱۹/۱۱

مقایسه حجم معاملات سهام در صندوق و بازار (۳ ماهه منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱):

شرح	حجم معاملات در صندوق	حجم معاملات بازار	درصد از حجم معاملات بازار
شرکت داروسازی سینا	۳.۳۰۶.۲۰۰	۹.۰۰۰.۶۶۲	۳۶/۷۳
شرکت بیمه سرمد	۴۹.۶۱۲.۸۷۵	۴۶۲.۸۳۵.۹۲۳	۱۰/۷۲
شرکت سرمایه‌گذاری صنایع ایران	۳۳.۶۶۰.۴۰۲	۱۶۹.۳۸۰.۹۷۷	۱۹/۸۷
شرکت بیمه رازی	۱۵۹.۲۶۵.۰۳۷	۱.۰۳۰.۳۸۰.۷۴۹	۱۵/۴۶
صندوق سرمایه‌گذاری دارا الگوریتم	۷۱۷.۷۱۶.۲۲۲	۷۴۱.۶۲۷.۲۷۴	۹۶/۷۸
صندوق سرمایه‌گذاری ارزش آفرین بیدار	۳۵.۷۶۳.۰۱۰	۶۶.۲۵۹.۵۵۱	۵۳/۹۷
صکوک اجاره خوارزم ۴۴۱-۶ماهه ۲۰٪	۳۴۸.۰۹۸	۳۴۸.۱۴۵	۹۹/۹۹

ترکیب دارایی‌های صندوق:

شرح	میانگین روزانه از ابتدای تأسیس صندوق		میانگین روزانه ۹۰ روز گذشته		میانگین روزانه ۳۰ روز گذشته		۱۴۰۱/۰۶/۳۱	
	مبلغ (*)	نسبت به کل دارایی (درصد)	مبلغ (*)	نسبت به کل دارایی	مبلغ (*)	نسبت به کل دارایی (درصد)		
سهام	۱۸۶.۶۹۶	۱۶/۷۴	۵۴۳.۲۷۴	۲۸/۶	۵۵۸.۴۱۱	۲۹/۵۷	۵۷۴.۴۱۶	۳۱/۲۸
اوراق	۱۰۲.۱۴۱	۹/۱۶	۴۹۵.۷۱۸	۲۶/۰۹	۲۹۳.۲۴۴	۱۵/۵۳	۲۹۷.۸۶۷	۱۶/۲۲
وجه نقد	۳۱.۷۲۹	۲/۸۵	۳۵.۳۰۲	۱/۸۶	۵.۱۸۱	۰/۲۷	۶.۲۱۹	۰/۳۴
سایر دارایی‌ها	۹.۴۱۹	۰/۹۴	۶۷.۳۱۶	۳/۵۴	۵۵.۳۱۱	۲/۹۳	۳۴.۳۸۰	۱/۸۷
صندوق سرمایه‌گذاری	۷۸۴.۰۱۴	۷۰/۳۱	۷۵۸.۲۳۰	۳۹/۹۱	۹۷۶.۲۴۲	۵۱/۷	۹۲۳.۴۵۳	۵۰/۲۹

مبالغ بر حسب میلیون ریال می باشد *

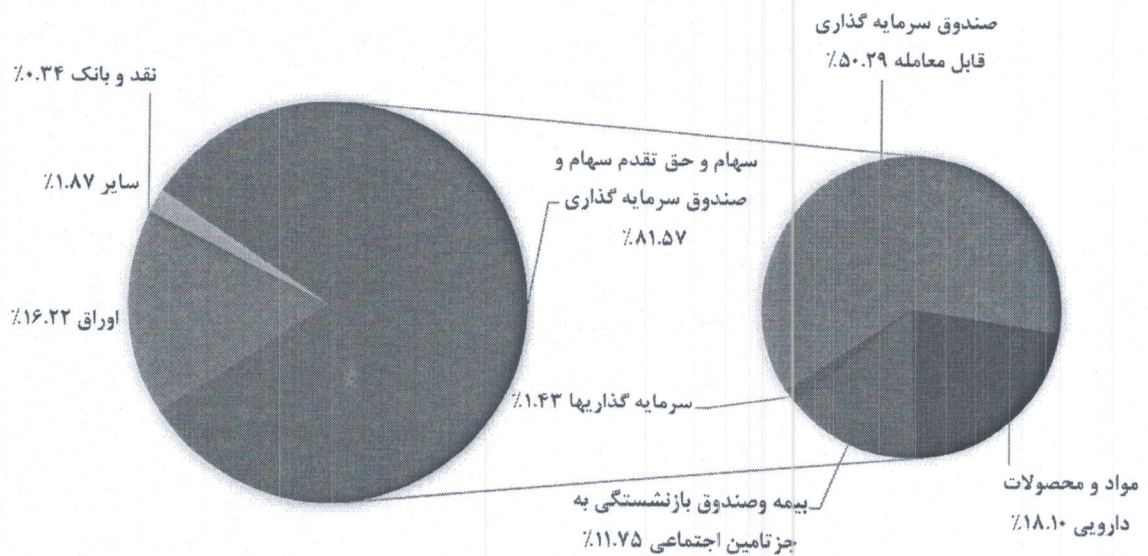
مبالغ بر حسب میلیون ریال می باشد *

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم
گزارش عملکرد

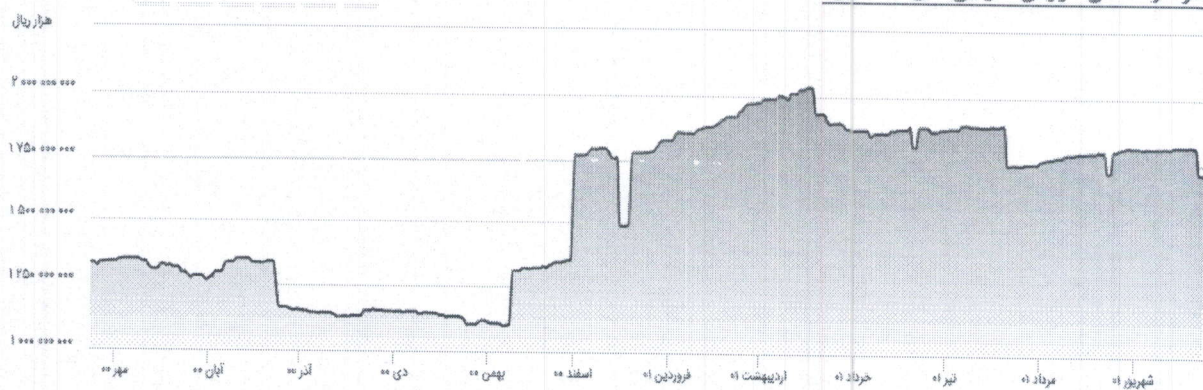
سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۱



نمودار ترکیب دارایی:



نمودار خالص ارزش دارایی‌های صندوق:



صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم

گزارش عملکرد

سال مالی منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۱



خلاصه عملکرد:

صندوق سرمایه‌گذاری اختصاصی بازارگردانی کوشا الگوریتم		
شرح	سال مالی منتهی به ۱۴۰۱/۰۶/۳۱	سال مالی منتهی به ۱۴۰۰/۰۶/۳۱
خالص ارزش روز دارائی‌ها (ریال)	۱.۷۱۰.۷۲۱.۵۷۲.۴۷۹	۱.۳۲۸.۴۹۲.۹۴۸.۵۵۶
قیمت صدور هر واحد (ریال)	۱.۲۳۸.۱۹۰	۱.۱۴۸.۹۹۷
قیمت ابطال هر واحد (ریال)	۱.۲۳۷.۲۵۷	۱.۱۴۷.۹۶۵
تعداد کل واحدهای سرمایه‌گذاری	۱.۳۸۲.۶۷۳	۱.۱۵۷.۲۵۹

استراتژی سرمایه‌گذاری صندوق:

به منظور مدیریت صحیح و مناسب صندوق و با توجه به فضای رقابتی بازار سرمایه، از ظرفیت و توانمندی‌های تیم مدیریتی و کارشناسی نهایت بهره‌ی لازم برده شده و با توجه به فرصت‌ها و تهدیدات پیش رو، جهت‌گیری‌های اصلی صندوق نقدشوندگی هر چه بیشتر اوراق بهادار موضوع بازارگردانی تحت مدیریت، کاهش نوسان آن و در نهایت کسب بازدهی بهینه سرمایه‌گذاران و برنامه‌ریزی برای ایجاد شرایط مناسب در جهت امکان تعریف اختیار فروش برای سهامدار عمده در صورت رضایت از روند سوددهی صندوق می‌باشد.

برنامه‌ها و فعالیت‌های آتی:

اهم برنامه‌ها و فعالیت‌های آتی صندوق بشرح زیر می‌باشد:

۱. افزایش اوراق بهادار موضوع بازارگردانی،
۲. تلاش در جهت جذب سرمایه‌های بیشتر و افزایش تعداد واحدهای صادره،
۳. افزایش نقدشوندگی اوراق موضوع بازارگردانی و حفظ ارزش آورده دارندگان واحدهای سرمایه‌گذاری،
۴. امکان‌سنجی تعریف اختیار فروش برای سهامدار عمده در صورت پیش‌بینی روند مثبت سوددهی شرکت،